



DATA SCIENCE & STOCK-PICKING

Long/Short Actions Européennes biais long



Fiche produit
Quantology Small



Il existe un phénomène de mimétisme entre les gérants Small-Mid Caps européennes qui s'explique par le formatage de la méthode de recherche, l'utilisation des mêmes maisons d'analyses, les interactions entre professionnels et un accès ouvert à l'information des portefeuilles. Capturer de façon systématique les meilleures idées des gérants de la catégorie est l'ambition du fonds.

STRATEGIE D'INVESTISSEMENT

Le fonds suit une stratégie de type long/short actions biais long. En patte longue, notre modèle de sélection propriétaire traque de façon systématique les 30 convictions les plus récemment repondérées par les 190 gérants de la catégorie small et mid cap européennes. La patte short est constituée de couvertures sur l'indice actions large cap européennes.

CONSTRUCTION DU FONDS

EXPOSITION NETTE ACTION: +40%

(Long-Short)

POCHE LONGUE

Exposition : +60%

POCHE SHORT

Exposition: 20%

SELECTION QUANTITATIVE

SMALL-MID CAPS

30 valeurs

INDICE LARGE CAPS

DJ STOXX EUROPE 600

PRICE INDEX EURO

CARACTERISTIQUES

- ✓ Fonds quantitatif L/S Actions Biais Long
- ✓ Sous-jacents: Small & Mid caps européennes
- ✓ Gérants: Julien Messias - Vincent Fourcaut
- ✓ Devise: Euro
- ✓ Indicateur de référence : 70% Eonia Capitalisé +30% Stoxx 600 TR
- ✓ Frais de gestion part I: 1,5% / part R: 2%
- ✓ Commission de surperformance : 20% > à l'indicateur de référence (High Water Mark)
- ✓ Code Isin Part I : FR0013256260
- ✓ Code Isin Part R: FR0013256278

RISQUES DU FONDS

- ✓ Risque actions
- ✓ Risque taux
- ✓ Risque de crédit
- ✓ Risque de modèle
- ✓ Risque de contrepartie

Références



Quantology CM est une société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP-13000028. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne sont pas constantes dans le temps et ne font l'objet d'aucune garantie. Document d'information non contractuel. Pour plus d'informations, veuillez vous référer au DICI (Document d'Information Clé pour l'Investisseur) disponible sur le site internet www.quantology-cm.com